

ИНФОРМАЦИЯ
СЪГЛАСНО ЧЛ. 72 ОТ НАРЕДБА № 44 ЗА ИЗИСКВАНИЯТА КЪМ
ДЕЙНОСТТА НА КИС, ИД ОТ ЗАТВОРЕН ТИП И УД

ДФ ТИ БИ АЙ КОМФОРТ

Съгласно инвестиционната политика и стратегия на Фонда за инвестиране предимно в облигации, търгувани на регулираните пазари в страната и чужбина и при разрешена експозиция в акции до 20% от размера на активите през периода са закупени акции и корпоративни облигации. Падежирали са и ипотечни облигации.

Към 30.06.2013г. акциите на български компании в портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт са разпределени в 5 икономически сектора. Общият дял на тези акции в активите на Фонда към 30.06.2013г. възлиза на 15.28%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 2.90% от активите на ДФ Ти Би Ай Комфорт.

Към 30.06.2013г. корпоративните облигации представляват 34.43% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Комфорт, а общинските - 2.05% от стойността на активите.

Банковите депозити съставляват 19.60% от общите активи на Фонда.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 30.06.2013г. са 7.03% от стойността на портфейла.

Вземанията във връзка с лихвено и главнично плащане по емисии корпоративни облигации, начислени дивиденди и платени такси към БФБ и КФН възлизат на 18.71% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 28.06.2013г. е 5.03% на годишна база*, доходността от началото на годината е 4.29%, а доходността за последните 12 месеца към 28.06.2013г. е 6.54%.

I. Данни по чл. 72, ал. 2 от Наредба № 44

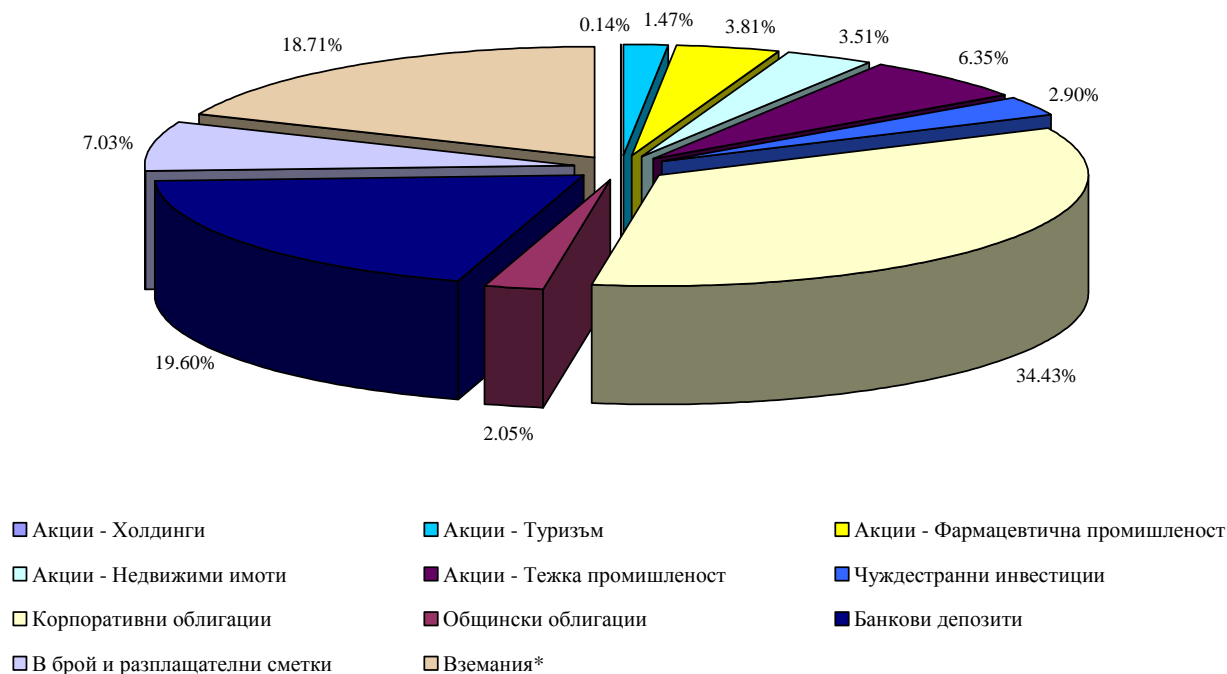
1) Данни по чл. 72, ал. 2, т. 1: Обем и структура на инвестициите в портфейла по емитенти и видове ценни книжа и финансови инструменти

Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт към 30.06.2013г. е представена в следната таблица и графика.

* Доходността е изчислена въз основа на нетната стойност на активите на един дял на съответните дати.

Структура на портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт към 30.06.2013 г.		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	994	0.14%
Акции - Туризм	10 720	1.47%
Акции - Фармацевтична промишленост	27 901	3.81%
Акции - Недвижими имоти	25 678	3.51%
Акции - Тежка промишленост	46 474	6.35%
Чуждестранни инвестиции	21 207	2.90%
Корпоративни облигации	251 747	34.43%
Общински облигации	14 984	2.05%
Банкови депозити	143 341	19.60%
В брой и разплащателни сметки	51 400	7.03%
Вземания*	136 783	18.71%
Общо активи	731 229	100.00%

* Вземания във връзка с начислени дивиденди, лихвено и главнично плащане по емисии корпоративни облигации, предварително платени такси към БФБ и КФН.

Разпределение на активите на Ти Би Ай Комфорт към 30/06/2013


2) Данни по чл. 72, ал. 2, т. 2: Видове деривативни инструменти, основни рискове, свързани с базовите активи на деривативните инструменти, количествени ограничения и избрани методи за оценка на риска, свързан със сделките с деривативни инструменти

Към настоящия момент, сключените от управляващото дружество сделки с деривативни инструменти са единствено с цел управление на риска – хеджиране.

Във връзка с притежаваните от Фонда валутно деноминирани активи, управляващото дружество извършва хеджиращи сделки с цел предпазване от валутния риск, на който е изложен Фонда. Хеджираните активи и сключените сделки са описани по-долу.

Рисков актив				
ISIN	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност
Валутно деноминиран актив	USD	1 703.82	1.000	\$1 703.82
Валутно деноминиран актив	USD	46.00	160.420	\$7 379.32
Валутно деноминиран актив	USD	99.00	68.720	\$6 803.28

Обща рискова позиция	\$15 886.42
-----------------------------	-------------

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 11 000.00	1.336400	\$14 700.40	OTC	България
Обща хеджираща позиция				\$14 700.40		

Красимир Петков
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД